

# 万家鑫安纯债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.11 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>47</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	47
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48

12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家鑫安纯债债券型证券投资基金	
基金简称	万家鑫安纯债	
基金主代码	003329	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 18 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,168,775,691.36 份	
下属分级基金的基金简称:	万家鑫安纯债 A	万家鑫安纯债 C
下属分级基金的交易代码:	003329	003330
报告期末下属分级基金的份额总额	15,168,770,801.36 份	4,890.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在满足基金资产良好流动性的前提下, 谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上, 采取积极主动地投资管理策略, 通过定性与定量分析, 对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估, 对不同投资品种运用不同的投资策略, 并充分利用市场的非有效性, 把握各种套利的机会。在信用风险可控的前提下, 寻求组合流动性与收益的最佳配比, 力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中债综合指数(总财富)收益率*90%+1 年期定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金, 其长期平均风险和预期收益率低于股票型和混合型基金, 高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	戴辉
	联系电话	021-38909626	010-65169958
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95508
传真		021-38909627	010-65169555
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	广东省广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	北京市东城区东长安街甲 2 号

邮政编码	200122	510080
法定代表人	方一天	杨明生

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金半年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)基金管理人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	万家鑫安纯债 A	万家鑫安纯债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	232,503,845.50	71.47
本期利润	286,827,505.78	89.22
加权平均基金份额本期利润	0.0189	0.0177
本期加权平均净值利润率	1.88%	1.77%
本期基金份额净值增长率	1.90%	1.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	121,304,713.91	38.23
期末可供分配基金份额利润	0.0080	0.0078
期末基金资产净值	15,290,075,515.27	4,928.23
期末基金份额净值	1.0080	1.0078
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.07%	1.90%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家鑫安纯债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.63%	0.02%	1.12%	0.06%	-0.49%	-0.04%
过去三个月	1.04%	0.02%	0.24%	0.07%	0.80%	-0.05%
过去六个月	1.90%	0.02%	-0.03%	0.07%	1.93%	-0.05%
自基金合同生效起至今	2.07%	0.03%	-1.08%	0.09%	3.15%	-0.06%

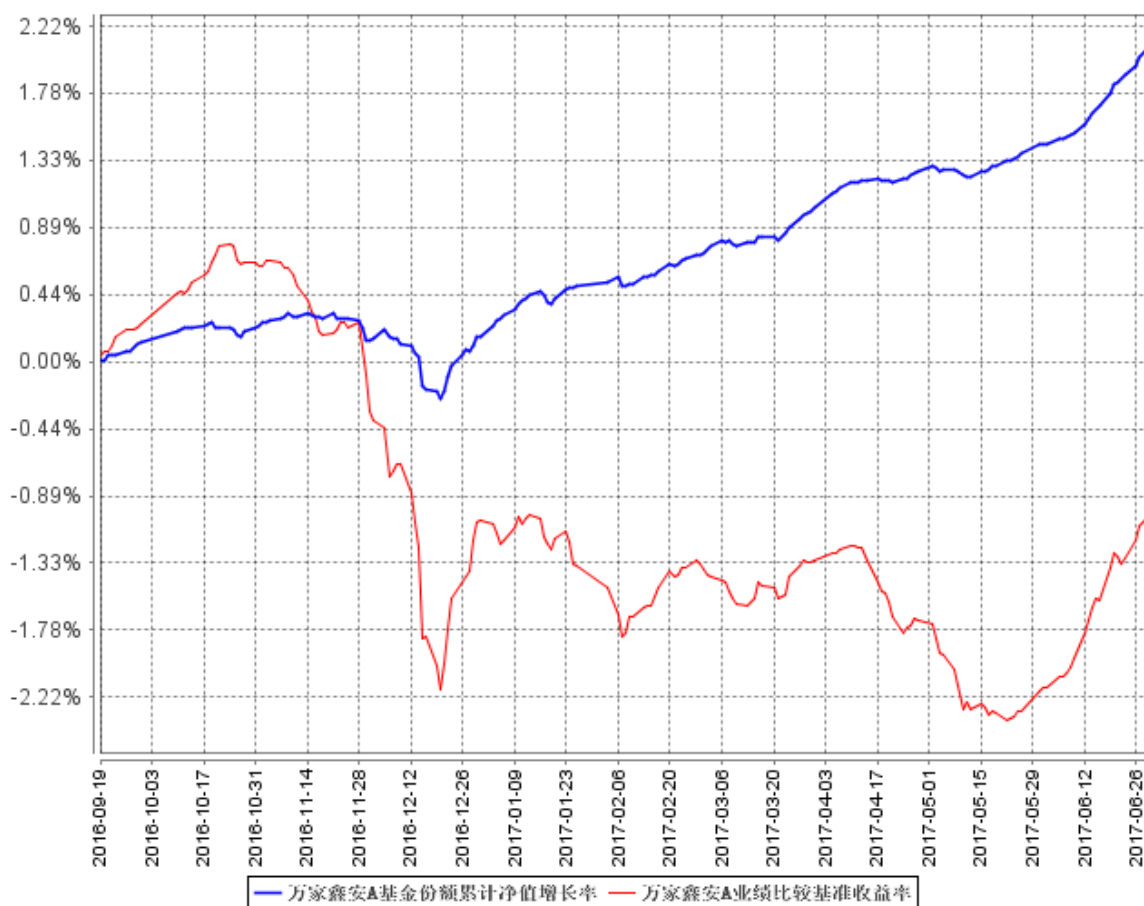


万家鑫安纯债 C

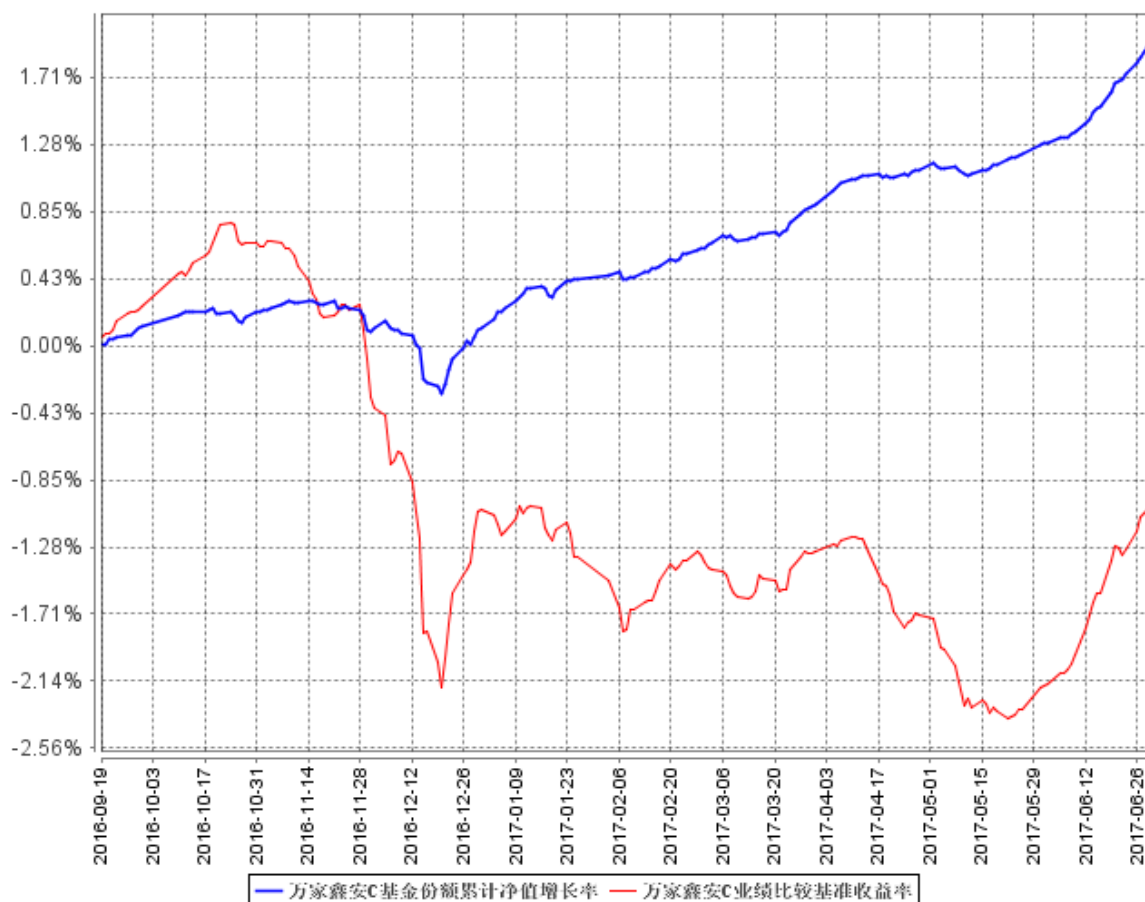
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.61%	0.02%	1.12%	0.06%	-0.51%	-0.04%
过去三个月	0.99%	0.02%	0.24%	0.07%	0.75%	-0.05%
过去六个月	1.79%	0.02%	-0.03%	0.07%	1.82%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.03%	-1.08%	0.09%	2.98%	-0.06%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家鑫安A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家鑫安C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 18 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

2、本基金报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),办公地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),注册资本1亿元人民币。目前管理四十九只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家恒景18个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家家泰债券型证券投资基金、万家家盛债券型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐俊杰	本基金基金经理、万家货币市场证券投资基金、万家恒利债券基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型基金、万家鑫璟纯债债券型基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。固定收益部总监	2016 年 9 月 18 日	-	9 年	硕士学位，曾任金元证券股份有限公司投资经理。2011 年 9 月加入万家基金管理有限公司，现任固定收益部总监
柳发超	现任万家恒瑞 18 个月定期开放债券型基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金基金经理。	2016 年 10 月 28 日	-	3 年	柳发超，CFA，上海财经大学硕士。2014 年 3 月至 2016 年 7 月任国海富兰克林基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理，2016 年加入万家基金管理有限公司。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理

办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统内的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经济或将进入被动补库存阶段,动能或将减弱。增长预期边际向下,但幅度或许不会很大。其中向下的动力主要来自地产投资回落,向上的动力主要来自全球经济回暖所带来的出口回升。通胀方面,核心 CPI 持续稳定,翘尾因素向下,下半年压力不大,大宗商品价格目前处于高位,下半年或将呈现弱势。总体来看下半年经济基本面、去杠杆以及外围经济变化是决定债市走向的主要因素。

融资方面,二季度大规模的债券取消发行,一级市场净融资量节节下滑。虽然近期一级市场融资有所回升,但实体融资压力的上升对实体经济的负面影响或将逐步显现。目前收益率曲线较平,随着时间推进曲线将会修正。

四五月份在理财监管政策风向趋严的背景下,信用债和利率债收益率均有明显上行,短端利

率处于高位使得收益率曲线整体较平。在六月份资金面超预期宽松，以及监管风向略微缓和的情况下，市场收益率有所回落。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家鑫安 A 基金份额净值为 1.0080 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.90%；截至本报告期末万家鑫安 C 基金份额净值为 1.0078 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.79%；同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们保持着较短的久期，净值波动较小。考虑到债市去杠杆尚未完全结束，保持短久期，票息为纲精选个券，积极参与利率债波段操作，将是下一阶段的主要投资思路。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金合同规定“基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；”2017年2月14日，本基金进行了利润分配，每十份基金份额分红0.0550元，共计分配83,428,264.49元；2017年5月26日，本基金进行了利润分配，每十份基金份额分红0.0710元，共计分配107,698,303.51元。符合基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低

于 5000 万的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管万家鑫安纯债债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人—广发银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《万家鑫安纯债债券型证券投资基金基金合同》、《万家鑫安纯债债券型证券投资基金托管协议》的约定,对万家鑫安纯债债券型证券投资基金管理人—万家基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,万家基金管理有限公司在万家鑫安纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的万家鑫安纯债债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：万家鑫安纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	804,615,800.26	7,279,843.48
结算备付金		57,726,750.36	919,109.71
存出保证金		147,243.95	40,136.30
交易性金融资产	6.4.7.2	13,864,288,888.00	15,327,243,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		12,743,030,288.00	15,138,744,000.00
资产支持证券投资		1,121,258,600.00	188,499,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,334,390,391.36	230,850,866.28
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	203,763,758.89	132,034,634.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,264,932,832.82	15,698,367,590.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		969,299,845.35	498,199,766.00
应付证券清算款		541,285.02	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,755,781.50	3,855,604.86
应付托管费		1,251,927.16	1,285,201.64
应付销售服务费		0.90	0.93
应付交易费用	6.4.7.7	80,494.21	68,104.91
应交税费		-	-

应付利息		-355,299.10	359,124.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	278,354.28	220,000.00
负债合计		974,852,389.32	503,987,802.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	15,168,775,691.36	15,168,776,060.70
未分配利润	6.4.7.10	121,304,752.14	25,603,727.03
所有者权益合计		15,290,080,443.50	15,194,379,787.73
负债和所有者权益总计		16,264,932,832.82	15,698,367,590.57

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，万家鑫安 A 基金份额净值 1.0080 元，基金份额总额 15168770801.36 份；万家鑫安 C 基金份额净值 1.0078 元，基金份额总额 4890.0 份。万家鑫安份额总额合计为 15168775691.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家鑫安纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		338,836,072.07	-
1.利息收入		288,358,574.74	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,360,323.84	-
债券利息收入		228,919,105.13	-
资产支持证券利息收入		15,875,998.25	-
买入返售金融资产收入		21,203,147.52	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,868,590.29	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,993,147.69	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	124,557.40	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	54,323,678.03	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	22,409.59	-

列)			
<b>减：二、费用</b>		52,008,477.07	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,665,797.32	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,555,265.69	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5.43	-
4. 交易费用	6.4.7.19	111,028.05	-
5. 利息支出		21,456,216.50	-
其中：卖出回购金融资产支出		21,456,216.50	-
6. 其他费用	6.4.7.20	220,164.08	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		286,827,595.00	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		286,827,595.00	-

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家鑫安纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,168,776,060.70	25,603,727.03	15,194,379,787.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	286,827,595.00	286,827,595.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-369.34	-1.89	-371.23
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-369.34	-1.89	-371.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-191,126,568.00	-191,126,568.00
五、期末所有者权益	15,168,775,691.36	121,304,752.14	15,290,080,443.50

(基金净值)			
--------	--	--	--

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____方一天_____	_____李杰_____	_____陈广益_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

万家鑫安纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1976号文《关于准予万家鑫安纯债债券型证券投资基金募集的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2016年9月9日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具安永华明(2016)验字第60778298\_B10号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年9月18日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币200,007,343.60元，以上实收基金（本息）合计为人民币200,006,643.12元，折合200,006,643.12份基金份额，其中，万家鑫安A份额为200,000,143.12份，万家鑫安C份额为6,500.00份。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、地方政府债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、可分离交易债券的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单和银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金业绩比较基准为：中债综合指数（总财富）收益率\*90%+1年期定期存款利率（税后）\*10%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于

证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定, 经国务院批准, 自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点, 金融业纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通

知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	4,615,800.26
定期存款	800,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	800,000,000.00
其他存款	-
合计：	804,615,800.26

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,766,772,479.32	1,750,095,688.00
	银行间市场	10,983,181,580.73	10,992,934,600.00
	合计	12,749,954,060.05	12,743,030,288.00
资产支持证券	1,122,783,357.40	1,121,258,600.00	-1,524,757.40
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,872,737,417.45	13,864,288,888.00	-8,448,529.45

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	1,194,240,391.36	-
买入返售证券_固定平台	140,150,000.00	-
合计	1,334,390,391.36	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	-
应收定期存款利息	3,159,721.98
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	25,977.00
应收债券利息	195,050,466.72
应收买入返售证券利息	2,364,262.62
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3,163,330.57
合计	203,763,758.89

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	80,494.21
合计	80,494.21

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	278,354.28
合计	278,354.28

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家鑫安纯债 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,168,770,910.70	15,168,770,910.70
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-109.34	-109.34
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-



本期末	15,168,770,801.36	15,168,770,801.36
-----	-------------------	-------------------

金额单位：人民币元

万家鑫安纯债 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,150.00	5,150.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-260.00	-260.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,890.00	4,890.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家鑫安纯债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	111,308,641.06	-85,704,919.56	25,603,721.50
本期利润	232,503,845.50	54,323,660.28	286,827,505.78
本期基金份额交易产生的变动数	-1.43	0.61	-0.82
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1.43	0.61	-0.82
本期已分配利润	-191,126,512.55	-	-191,126,512.55
本期末	152,685,972.58	-31,381,258.67	121,304,713.91

单位：人民币元

万家鑫安纯债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34.63	-29.10	5.53
本期利润	71.47	17.75	89.22
本期基金份额交易产生的变动数	-2.33	1.26	-1.07
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2.33	1.26	-1.07
本期已分配利润	-55.45	-	-55.45

本期末	48.32	-10.09	38.23
-----	-------	--------	-------

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	47,605.99
定期存款利息收入	22,096,860.88
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	214,813.67
其他	1,043.30
合计	22,360,323.84

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,993,147.69
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-3,993,147.69

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,842,791,225.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,523,812,005.15

减：应收利息总额	322,972,367.80
买卖债券差价收入	-3,993,147.69

### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	160,270,483.45
减：卖出资产支持证券成本总额	152,737,442.60
减：应收利息总额	7,408,483.45
资产支持证券投资收益	124,557.40

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期末无股利收益。

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	54,323,678.03
——股票投资	-330,121.01
——债券投资	51,628,041.64
——资产支持证券投资	3,025,757.40
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	54,323,678.03

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	22,409.59
合计	22,409.59

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	465.55
银行间市场交易费用	110,562.50
合计	111,028.05

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
其他	3,809.80
帐户维护费	18,000.00
合计	220,164.08

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《万家鑫安纯债债券型证券投资基金分红公告》，本基金于 2017 年 8 月 23 日分红，A 类份额每十份分 0.1320 元，C 类份额每十份分 0.1270 元。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
广发银行股份有限公司（“广发银行”）	基金托管人、基金代销机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金报告期末通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金报告期末通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,665,797.32	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,555,265.69	-

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家鑫安纯债 A	万家鑫安纯债 C	合计
万家基金管理有限公司	-	5.43	5.43
广发银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	5.43	5.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家鑫安纯债 A	万家鑫安纯债 C	合计

注：基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金销售服务年费率为 0.20%，计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人指令于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给各代销机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

本基金无上年度可比期间对比数据。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
广发银行股 份有限公司	-	-	-	-	10,938,190,000.00	1,121,373.05

注:本基金为本报告期内合同生效的基金,无上年度可比期间对比数据

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有 限公司	4,615,800.26	47,605.99	-	-

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司,2017 年度获得的利息收入为人民币 214,813.67 元,2017 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 57,726,750.36 元。本基金成立日期为 2016 年 9 月 18 日,故无上年度可比期间。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本年度及上年度末均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 万家鑫安纯债 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
1	2017 年 5 月 26 日	2017 年 5 月 26 日	0.0710	107,698,272.68	-	107,698,272.68	
2	2017 年 2 月 14 日	2017 年 2 月 14 日	0.0550	83,428,239.87	-	83,428,239.87	
合计	-	-	0.1260	191,126,512.55	-	191,126,512.55	

#### 万家鑫安纯债 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
1	2017 年 5 月 26 日	2017 年 5 月 26 日	0.0628	30.83	-	30.83	
2	2017 年 2 月 14 日	2017 年 2 月 14 日	0.0479	24.62	-	24.62	
合计	-	-	0.1107	55.45	-	55.45	

### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末持有因认购新发/增发证券而流通受限制的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购



证券款余额 69,299,845.35 元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
160311	16 进出 11	2017 年 7 月 3 日	99.58	700,000	69,706,000.00
合计				700,000	69,706,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 900,000,000.00 元,该卖出回购证券款于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面,建立了三道防线:以各岗位目标责任制为基础,形成第一道防线;通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡,形成第二道防线;由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈,形成第三道防线。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,

以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	40,032,000.00	198,920,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	9,254,136,000.00	13,663,953,000.00
合计	9,294,168,000.00	13,862,873,000.00

注：未评级债券包括国家政策金融债、同业存单及超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	2,957,967,600.00	495,900,000.00
AAA 以下	190,957,000.00	177,974,000.00
未评级	1,421,196,288.00	601,997,000.00
合计	4,570,120,888.00	1,275,871,000.00

注：未评级债券包括国债及政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易;因此,除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、部分应收申购款、债券投资及买入返售金融资产等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	304,615,800.26	500,000,000.00	-	-	-	-	804,615,800.26
结算备付金	57,726,750.36	-	-	-	-	-	57,726,750.36
存出保证金	147,243.95	-	-	-	-	-	147,243.95
交易性金融资产	1,844,745,000.00	4,378,560,000.00	3,651,370,600.00	3,799,053,288.00	190,560,000.00	-	13,864,288,888.00
买入返售金融资产	1,334,390,391.36	-	-	-	-	-	1,334,390,391.36
应收利息	-	-	-	-	-	203,763,758.89	203,763,758.89
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,541,625,185.93	4,878,560,000.00	3,651,370,600.00	3,799,053,288.00	190,560,000.00	203,763,758.89	16,264,932,832.82
负债							
卖出回购金融资产	969,299,845.35	-	-	-	-	-	969,299,845.35

款							
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	541,285.02	541,285.02
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	3,755,781.50	3,755,781.50
应付 托管 费	-	-	-	-	-	1,251,927.16	1,251,927.16
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	0.90	0.90
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	80,494.21	80,494.21
应付 利息	-	-	-	-	-	-355,299.10	-355,299.10
其他 负债	-	-	-	-	-	278,354.28	278,354.28
负债 总计	969,299,845.35	-	-	-	-	5,552,543.97	974,852,389.32
利率 敏感 度缺 口	2,572,325,340.58	4,878,560,000.00	3,651,370,600.00	3,799,053,288.00	190,560,000.00	198,211,214.92	15,290,080,443.50
上年 度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行 存款	7,279,843.48	-	-	-	-	-	7,279,843.48
结算 备付 金	919,109.71	-	-	-	-	-	919,109.71
存出	40,136.30	-	-	-	-	-	40,136.30

保证金							
交易性金融资产	2,058,506,000.00	4,078,593,000.00	8,327,771,000.00	668,133,000.00	194,240,000.00		-15,327,243,000.00
买入返售金融资产	230,850,866.28						230,850,866.28
应收利息						132,034,634.80	132,034,634.80
其他资产							
资产总计	2,297,595,955.77	4,078,593,000.00	8,327,771,000.00	668,133,000.00	194,240,000.00	132,034,634.80	15,698,367,590.57
负债							
卖出回购金融资产款	498,199,766.00						498,199,766.00
应付管理人报酬						3,855,604.86	3,855,604.86
应付托管费						1,285,201.64	1,285,201.64
应付销售服务费						0.93	0.93
应付交易费用						68,104.91	68,104.91
应付利息						359,124.50	359,124.50
其他负债						220,000.00	220,000.00
负债总计	498,199,766.00					5,788,036.84	503,987,802.84
利率敏感	1,799,396,189.77	4,078,593,000.00	8,327,771,000.00	668,133,000.00	194,240,000.00	126,246,597.96	15,194,379,787.73

度缺 口						
---------	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金、存出保证金、部分应收申购款以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	32,541,448.50	22,014,551.93
	市场利率上升 25 个基点	-32,249,083.38	-21,845,691.10

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	13,864,288,888.00	90.68	15,327,243,000.00	100.87
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	13,864,288,888.00	90.68	15,327,243,000.00	100.87

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	股票基准指数下降100个基点	-	-
股票基准指数上升100个基点	-	-	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	13,864,288,888.00	85.24
	其中：债券	12,743,030,288.00	78.35
	资产支持证券	1,121,258,600.00	6.89
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,334,390,391.36	8.20
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	862,342,550.62	5.30
7	其他各项资产	203,911,002.84	1.25
8	合计	16,264,932,832.82	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。



### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	422,914,288.00	2.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,486,316,000.00	9.72
	其中：政策性金融债	1,486,316,000.00	9.72
4	企业债券	1,584,922,000.00	10.37
5	企业短期融资券	751,533,000.00	4.92
6	中期票据	442,744,000.00	2.90
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	8,054,601,000.00	52.68
9	其他	-	-
10	合计	12,743,030,288.00	83.34

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	111710218	17 兴业银行 CD218	4,000,000	395,680,000.00	2.59
2	111615297	16 民生 CD297	3,500,000	338,450,000.00	2.21
3	170012	17 付息国债 12	3,300,000	330,759,000.00	2.16
4	136895	17 中信 G1	3,000,000	298,500,000.00	1.95
5	111707139	17 招商银行 CD139	3,000,000	296,700,000.00	1.94

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1789013	17 光盈 1A	5,000,000	473,900,000.00	3.10
2	1689273	16 华驭 5A	1,900,000	189,392,000.00	1.24
3	1789096	17 速利银丰 1A	2,000,000	154,840,000.00	1.01
4	1789033	17 融腾 1 优先	1,300,000	83,135,000.00	0.54
5	1789077	17 福元 1A	1,000,000	78,060,000.00	0.51

6	1789164	17 惠益 1A1	660,000	65,984,600.00	0.43
7	1789120	17 融腾 2A2	500,000	50,155,000.00	0.33
8	1789119	17 融腾 2A1	400,000	25,792,000.00	0.17

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金暂不可投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

#### 7.11.2

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	147,243.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	203,763,758.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,911,002.84

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
万家鑫安纯债 A	36	421,354,744.48	15,168,769,767.58	100.00%	1,033.78	0.00%
万家鑫安纯债 C	169	28.93	0.00	0.00%	4,890.00	100.00%
合计	205	73,994,027.76	15,168,769,767.58	100.00%	5,923.78	0.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家鑫安纯债 A	268.38	0.0000%
	万家鑫安纯债 C	1,810.00	37.0143%
	合计	2,078.38	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家鑫安纯债 A	0~10
	万家鑫安纯债 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	万家鑫安纯债 A	0
	万家鑫安纯债 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家鑫安纯债 A	万家鑫安纯债 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 18 日）基金份额总额	200,000,143.12	6,500.00
本报告期期初基金份额总额	15,168,770,910.70	5,150.00
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	109.34	260.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	15,168,770,801.36	4,890.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

报告期内无涉及基金管理人的重大人事变动。

基金托管人：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

川财证券	2	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
川财证券	460,602,049.12	100.00%	48,892,000,000.00	100.00%	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	15,168,769,767.58	-	-	15,168,769,767.58	100.00
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家鑫安纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家鑫安纯债债券型证券投资基金合同》。
- 3、《万家鑫安纯债债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 6、万家鑫安纯债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告原文。
- 7、万家基金管理有限公司董事会决议。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日